

Державний вищий навчальний заклад
«Донецький національний технічний університет»
Кафедра управління і фінансово-економічної безпеки

«ЗАТВЕРДЖУЮ»

Перший проректор

_____ Леонід Бачурін

« _____ » _____ 2022 р.

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

УПРАВЛІННЯ ФІНАНСОВИМИ РИЗИКАМИ

(шифр і назва навчальної дисципліни)

Рівень освіти: перший (бакалаврський), другий (магістерський)

Спеціальність 072 Фінанси, банківська справа та страхування

(шифр і назва спеціальності)

Мова навчання: українська

Луцьк – 2022

Робоча програма навчальної дисципліни «Управління фінансовими ризиками» для здобувачів вищої освіти за спеціальністю 072 Фінанси, банківська справа і страхування.

«_____» _____ 2022 року. – 6 с.

Розробники: В.М. Антоненко, к.е.н., доцент, доцент кафедри управління і фінансово-економічної безпеки

Робоча програма затверджена на засіданні кафедри управління і фінансово-економічної безпеки
(назва кафедри)

Протокол № 1 від. “ 31 ” _____ 08 _____ 20 22 р.

Завідувачка кафедрою управління і фінансово-економічної безпеки

_____ (Ольга ПОПОВА)
(підпис) (прізвище та ініціали)
“ 31 ” _____ 08 _____ 20 22 р.

Схвалено науково-методичною комісією 07 Управління та адміністрування
(шифр, назва)

Протокол № від. “ ” _____ 20 р.

“ ” _____ 20 р. Голова _____ (Ярослав ЛЯШОК)
(підпис) (прізвище та ініціали)

1. Загальна інформація

Рівень освіти	Перший (бакалаврський)		Другий (магістерський)
Форма навчання	Денна	Заочна	
Статус	вибіркова		
Обсяг в кредитах ЄКТС	6		5
Обсяг в годинах за навчальним планом, разом: в тому числі:	180		150
лекції:	32 години	6 годин	
практичні заняття:	48 годин	6 годин	
лабораторні заняття:	-		
семінари:	-		
самостійна робота:	100 годин	168 годин	138 годин
Форма підсумкового контролю	Екзамен диф. залік (курсова робота)		
Дисципліну викладають	Викладач: Антоненко Валентина Миколаївна https://donntu.edu.ua/fem/ufeb valentyna.antonenko@donntu.edu.ua		

Передумови для вивчення дисципліни:

перелік дисциплін, які мають бути вивчені раніше:
гроші та кредит, фінанси, фінансовий аналіз.

2. Мета вивчення навчальної дисципліни

Мета навчальної дисципліни: формування у студентів знань основних положень теорії і практики ризик-менеджменту в сфері фінансових взаємовідносин суб'єктів господарської діяльності, вироблення навичок прийняття рішень з проблем виявлення, ідентифікації та мінімізації ризиків.

3. Очікувані результати навчання

Формуються у відповідності до поставленої мети навчальної дисципліни.

Після вивчення дисципліни студент повинен:

знати:

- існуючі підходи та дискусійні питання щодо визначення сутності економічних і фінансових ризиків, їх класифікацію та методи управління ними;
- проблеми управління фінансовими ризиками в сучасній економіці;
- основні сфери застосування отриманих знань;
- класифікацію основних фінансових ризиків і методику оцінки їх впливу;
- теорію виявлення системи цільових факторів вартості компанії;
- підходи до оцінки ризику;
- кількісні методи оцінки ризику;
- способи протидії фінансовому ризику;

вміти:

- вільно орієнтуватися в термінології курсу, пояснювати терміни, що зустрічаються в теоретичному викладі;
- визначати роль фінансових інструментів у зниженні фінансових ризиків інвесторів, досліджувати їх структуру і механізм функціонування;
- аналізувати процеси, що відбуваються на фінансових ринках та їх вплив на діяльність компаній;
- аналізувати отримувану з даних бухгалтерського обліку інформацію;
- обробляти вихідну фінансову інформацію для оцінки фінансових ризиків та ефективності управління ними.

4. Засоби діагностики результатів навчання

Засобами оцінювання та методами демонстрування результатів навчання є:

- екзамен;
- стандартизовані тести;
- доповіді на практичних заняттях;
- презентації результатів виконаних завдань та досліджень;
- виступи на наукових заходах (семінарах та конференціях);
- інші види індивідуальних та групових завдань.

Поточний контроль здійснюється під час проведення практичних занять і має на меті як перевірку рівня підготовленості студента до виконання конкретної роботи, так і оцінювання виконання відповідних робіт. Форма проведення поточного контролю під час навчальних занять і система оцінювання рівня знань студентів визначаються відповідно до розподілу балів за темами навчальної дисципліни.

Підсумковий контроль проводиться як семестровий при проведенні іспиту з навчальної дисципліни.

5. Критерії оцінювання результатів навчання

Критерії оцінювання формують порядок оцінювання під час поточного контролю (за результатами практичних занять та виконання індивідуальних або групових завдань) та підсумкового контролю.

Поточний контроль (в чисельнику – максимальний бал при правильному і своєчасному виконанні завдання; в знаменнику – мінімальний бал при правильному, але несвоечасному виконанні завдання)											Максимальний / мінімальний бал за результатами:		
Пр. 1	Пр. 2	Пр. 3	Пр. 4	Пр. 5	...	Пр. 20	Пр. 21	Пр. 22	Пр. 23	Пр. 24	поточного контролю	іспиту	всього
денна форма													
1	1	1	1	2	...	2	1	1	1	1	40	60	100
0,5	0,5	0,5	0,5	1	...	1	0,5	0,5	0,5	0,5	20	40	60
заочна форма													
12	14	14							40	60	100
6	7	7							20	40	60

Для оцінювання курсових робіт застосовується наступна шкала:

Пояснювальна записка	Графічна частина	Захист роботи	Максимальний бал
до 20	до 20	60	100

Результати підсумкового контролю оцінюються за 100-бальною шкалою та чотирибальною («відмінно», «добре», «задовільно», «незадовільно»).

Відповідність між шкалами встановлюється наступним чином:

Оцінка	
За 100-бальною шкалою	Для екзамену
90-100	відмінно
74-89	добре
60-73	задовільно
0-59	незадовільно

6. Програма навчальної дисципліни

6.1. Основні теми дисципліни

Тема 1. Загальні поняття невизначеності та ризику.

Тема 2. Теоретико-методологічні засади управління фінансовими ризиками економічних суб'єктів.

Тема 3. Аналіз та оцінювання рівнів фінансових ризиків.

Тема 4. Якісний аналіз фінансових ризиків.

Тема 5. Кількісний аналіз фінансових ризиків.

Тема 6. Політика управління фінансовими ризиками.

Тема 7. Механізм нейтралізації фінансових ризиків.

6.2. Теми практичних (семінарських) занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин	
		Д.ф.н.	З.ф.н.
1	Тема 1. Загальні поняття невизначеності та ризику.	6	1
2	Тема 2. Теоретико-методологічні засади управління фінансовими ризиками економічних суб'єктів	6	
3	Тема 3. Аналіз та оцінювання рівнів фінансових ризиків	6	1
4	Тема 4. Якісний аналіз фінансових ризиків	6	1
5	Тема 5. Кількісний аналіз фінансових ризиків	8	1
6	Тема 6. Політика управління фінансовими ризиками	8	1
7	Тема 7. Механізм нейтралізації фінансових ризиків	8	1
Усього годин		48	6

6.3. Теми лабораторних занять

Лабораторні заняття не передбачені навчальним планом.

6.4. Самостійна робота

№ з/п	Назва теми	Кількість годин		
		Рівень освіти		
		Перший		Другий
		Д.ф.н.	З.ф.н.	
1	Тема 1. Загальні поняття невизначеності та ризику.	10	16	16
2	Тема 2. Теоретико-методологічні засади управління фінансовими ризиками економічних суб'єктів	10	20	20
3	Тема 3. Аналіз та оцінювання рівнів фінансових ризиків	10	20	20
4	Тема 4. Якісний аналіз фінансових ризиків	10	18	18
5	Тема 5. Кількісний аналіз фінансових ризиків	10	20	20
6	Тема 6. Політика управління фінансовими ризиками	10	20	20
7	Тема 7. Механізм нейтралізації фінансових ризиків	10	24	24
8	Виконання курсової роботи	30	30	-
Усього годин		100	168	138

6.5. Індивідуальні та/або групові завдання

Основна мета виконання студентами індивідуальних робіт – закріпити знання, отримані ними під час лекційних і практичних занять, поглиблено дослідити окремі тематичні питання навчальної дисципліни.

До індивідуальних завдань відносяться: підготовка доповідей, підготовка тез до виступу на конференціях, участь в конкурсах наукових робіт тощо.

Тематика курсових робіт, зміст та вимоги до теоретичної і практичної частин роботи наведені в методичній розробці (№ М910 в каталозі бібліотеки ДонНТУ):

Методичні рекомендації до виконання курсової роботи з навчальної дисципліни «Управління фінансовими ризиками» для студентів всіх форм навчання галузі знань 07 Управління та адміністрування спеціальності 072 Фінанси, банківська справа та страхування [Електронний ресурс] / уклад. В.М. Антоненко, Л.Л. Катранжи, Ю.О. Коваленко, А.С. Марина. – Покровськ : ДонНТУ, 2020. – 34 с.

7. Література

7.1. Основна

1. Бортник С.М. Особливості виявлення та управління ризиками в контексті забезпечення фінансової безпеки держави. *Економічна безпека держави в контексті національних інтересів*. 2021. Режим доступу : <http://dspace.univd.edu.ua/xmlui/bitstream/handle/123456789/1>

- 0501/Osoblyv osti%20vyiavlennia_Bortnyk_2021.pdf?sequence=1&isAllowed=y.
2. Грабчук О.М. Опорний конспект лекцій з дисципліни «Управління фінансовими ризиками». Режим доступу : http://repository.dnu.dp.ua:1100/upload/0eb82a4709b50dff3819a3771f74e08bOpornij-konspekt_Upravlinnya_finansovimi_rizikami.pdf.
 3. Даниленко А.І. Фінансові ризики: їх сутність та оцінювання на підприємствах України. *Фінанси України*. 2020. № 3. С. 7-22.
 4. Куцик П.О., Васильців Т.Г., Сороківський В.М., Стефаняк В.І., Сороківська М.В. Управління фінансовими ризиками : навч. посіб. Львів : Растр-7, 2016, 318 с.
 5. Лактіонова О.А. Управління фінансовими ризиками: навчальний посібник. Вінниця: ДонНУ імені Василя Стуса, 2020. 256 с.
 6. Посохов І.М. Управління ризиками у підприємництві : навч. посіб. Харків : НТУ «ХП», 2015. 220 с.
 7. Про затвердження Положення про організацію системи управління ризиками в банках України та банківських групах : Постанова НБУ від 11.06.2018 № 64. Режим доступу : <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/v0064500-18#n16>.
 8. Про затвердження Положення про управління ризиками, пов'язаними з наданням державних гарантій, та розподіл таких ризиків між державою, кредитором і позичальником : Постанова КМУ від 23.02.2011 № 131. Режим доступу : <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/131-2011-%D0%BF#Text>.
 9. Розділ 9. Управління фінансовими ризиками. Режим доступу: https://fin.fem.sumdu.edu.ua/images/My_files/FinManagement/Finmen2012/glava_9.pdf.
 10. Ризик-менеджмент у сфері фінансових послуг : конспект лекцій ; укладачі : В.М. Олійник, С.М. Фролов, І.М. Кобушко. Суми : Сумський державний університет, 2014. 132 с.
 11. Шклярук С.Г. Управління фінансовими ризиками : навч. посіб. К. : ДП «Вид. дім «Персонал», 2019. 494 с. Режим доступу: https://maup.com.ua/assets/files/lib/book/upr_fin_ryzik.pdf.

7.2. Методична

1. Методичні рекомендації до самостійного вивчення дисципліни (в розробці).
2. Методичні рекомендації до виконання курсової роботи з навчальної дисципліни «Управління фінансовими ризиками» для студентів всіх форм навчання галузі знань 07 Управління та адміністрування спеціальності 072 Фінанси, банківська справа та страхування [Електронний ресурс] / уклад. В.М. Антоненко, Л.Л. Катранжи, Ю.О. Коваленко, А.С. Марина. – Покровськ : ДонНТУ, 2020. – 34 с. Режим доступу: <http://ea.donntu.edu.ua:8080/jspui/handle/123456789/32807>.
3. Схемоконспект лекцій з навчальної дисципліни «Управління фінансовими ризиками» для студентів всіх форм навчання галузі знань 07 Управління та адміністрування / Уклад. В.М. Антоненко. – Покровськ : ДонНТУ, 2022. – 301 с. Режим доступу: <http://ea.donntu.edu.ua:8080/jspui/handle/123456789/33587>.
4. Методичні рекомендації та завдання до практичних занять з навчальної дисципліни «Управління фінансовими ризиками» для студентів всіх форм навчання галузі знань 07 «Управління та адміністрування» / Уклад. В.М. Антоненко. Луцьк : ДонНТУ, 2022. – 35с.

8. Інформаційні ресурси

www.president.gov.ua – офіційний сайт Президента України
www.rada.gov.ua – офіційний сайт Верховної Ради України
www.ac-rada.gov.ua – офіційний сайт Рахункової палати України
www.kmu.gov.ua – офіційний сайт Кабінету міністрів України
www.minfin.gov.ua – офіційний сайт Міністерства фінансів України
www.treasury.gov.ua – офіційний сайт Державного казначейства України
www.minjust.gov.ua – Офіційний сайт Міністерства Юстиції України
www.minrd.gov.ua – Офіційний сайт Державної фіскальної служби України
www.visnuk.com.ua/ – Вісник Державної фіскальної служби України.